

# 万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金

## 2019 年年度报告摘要

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2020 年 3 月 25 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料已经审计，立信会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	万家品质生活
基金主代码	519195
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 8 月 6 日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,035,560,427.21 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于中国经济社会发展过程中所涌现出的能够直接或间接满足居民生活品质提升需求的上市公司，在严格控制投资风险的基础上，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	随着中国社会经济的发展、居民收入水平的提升和城镇化进程的推进，居民的各方面需求将逐步释放，尤其是对于生活品质的要求会逐步提高，由此带来对相关产品和服务的需求增加，并推动提供此类产品和服务的上市公司的快速成长。本基金将重点把握居民生活品质提升、消费结构升级的趋势，运用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法优选行业和精选股票，并构建基金的投资组合。一方面，本基金通过“自上而下”的深入分析，在综合国内外宏观经济发展趋势、国家相关政策的基础上，优化大类资产配置、甄选受益行业；另一方面，通过“自下而上”的深入研究，精选具有核心竞争力、成长性突出且价值低估的上市公司，依靠这些公司的出色成长能力来抵御经济和行业的不确定性和各种压力，力争获得超越市场平均水平的长期回报。
业绩比较基准	50%*沪深 300 指数收益率+50%*上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	贺倩
	联系电话	021-38909626	010-66060069

	电子邮箱	lanj@wjasset.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008880800	95599
传真		021-38909627	010-68121816

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.wjasset.com">http://www.wjasset.com</a>
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼 基金管理人办公场所

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	-187,282,091.07	22,090,782.84	110,816,547.67
本期利润	1,124,069,192.81	-1,012,647,556.89	50,862,521.72
加权平均基金份额本期利润	0.3894	-0.3157	0.1137
本期基金份额净值增长率	47.74%	-21.46%	31.54%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1483	-0.1036	0.2564
期末基金资产净值	1,371,403,900.80	3,880,122,758.08	2,668,678,638.41
期末基金份额净值	1.3243	0.8964	1.2564

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

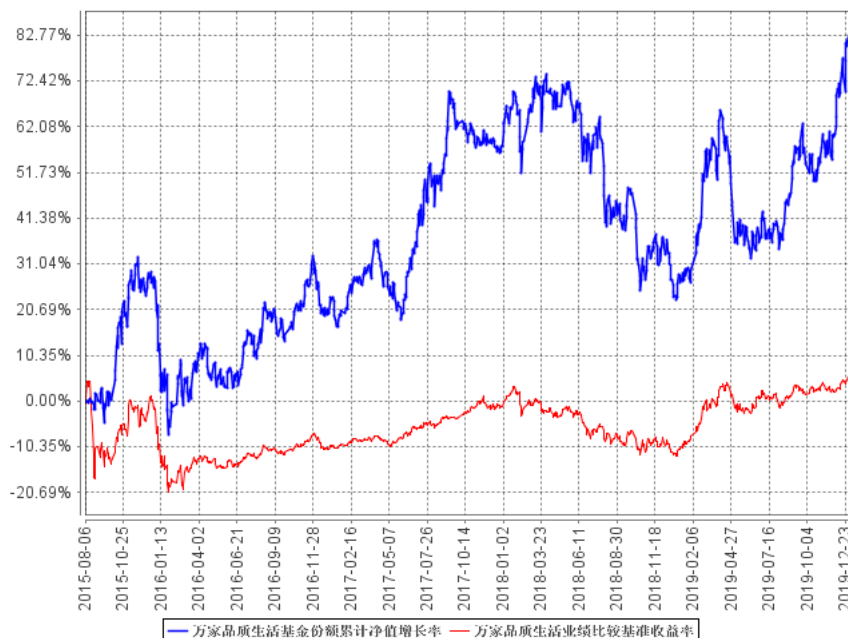
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	19.01%	1.37%	4.19%	0.37%	14.82%	1.00%
过去六个月	33.52%	1.32%	4.78%	0.43%	28.74%	0.89%
过去一年	47.74%	1.47%	19.73%	0.62%	28.01%	0.85%
过去三年	52.62%	1.38%	18.55%	0.56%	34.07%	0.82%
自基金合同生效起至今	82.88%	1.54%	5.70%	0.87%	77.18%	0.67%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

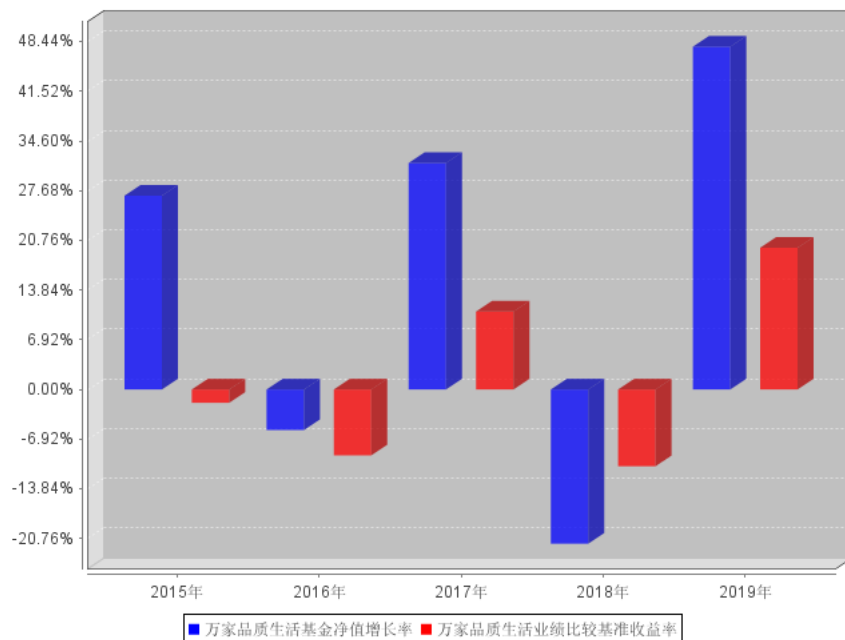
万家品质生活基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金成立于 2015 年 8 月 6 日，建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。本基金已于 2016 年 3 月 8 日召开基金持有人大会，对本基金的名称、基金投资范围等事项进行相应修改。根据基金份额持有人大会决议，原“万家品质生活股票型证券投资基金”更名为“万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金”。基金管理人已将修改后的《万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金托管协议》和《万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》报中国证监会进行变更注册，修订和更新后的文件于 2016 年 3 月 8 日生效。报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家品质生活自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2019	-	-	-	-	
2018	0.9800	399,101,425.02	40,274,634.84	439,376,059.86	
2017	3.2000	590,980,598.44	85,134,173.67	676,114,772.11	
合计	4.1800	990,082,023.46	125,408,808.51	1,115,490,831.97	

注：本基金 2019 年度未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。公司现股东为中泰证券股份有限公司、新疆国际实业股份有限公司和齐河众鑫投资有限公司,住所:中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8楼(名义楼层9层),办公地点:上海市浦东新区浦电路360号9楼,注册资本3亿元人民币。目前管理七十只开放式基金,分别为万家180指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金(LOF)、万家添利债券型证券投资基金(LOF)、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金、万家颐和灵活配置混合型证券投资基金、万家恒瑞18个月定期开放债券型证券投资基金、万家3-5年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家沪深300指数增强型证券投资基金、万家家享中短债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家1-3年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家中证1000指数增强型发起式证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵



活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金和万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
莫海波	万家和谐增长混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家臻选混合	2015 年 8 月 6 日	-	9.5 年	美国圣约翰大学 MBA。2010 年 3 月至 2011 年 2 月在财富证券有限责任公司任分析师、投资经理助理，2011 年 2 月至 2015 年 3 月在中银国际证券有限责任公司任投资经理；2015 年 3 月进入万家基金管理有限公司，从事投资研究工作，自 2015 年 5 月起担任基金经理职务，现任公司总经理助理、投资研究部总监、基金经理。

	型证券投资基金、 万家社会责任18个 月定期开放混合型 证券投资基金 (LOF)基金 基金经理				
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋取最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《万家基金管理有限公司公平交易管理办法》，涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送，确保公平对待不同投资组合。

在投资决策上：(1) 公司对不同类别的投资组合分别设定独立的投资部门，公募基金经理和特定客户资产管理投资经理不得互相兼任。(2) 公司投资管理实行分层次决策，投资决策委员会下设的公募基金投资决策小组和专户投资决策小组分别根据公募基金和专户投资组合的规模、风格特征等因素合理确定各投资组合经理的投资权限，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需经过严格的逐级审批程序。(3) 公司接受的外部研究报告、研究员撰写的研究报告等均通过统一的投研管理平台发布，确保各投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施决策方面享有公平的机会。

在交易执行上：(1) 公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度；(2) 对于交易公开竞价交易，所有指令必须通过系统下达，公司执行交易系统内的公平交易程序；(3) 对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各

投资组合的交易价格和数量,公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;(4)对于银行间交易,交易部按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。

在行为监控上,公司定期对不同投资组合的同向交易价差、反向交易,场外交易对手议价的價格公允性及其他异常交易情况进行监控及分析,基金经理对异常交易情况进行合理性解释并留存记录,并定期编制公平交易分析报告,由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司定期进行同向交易价差分析,即采集公司旗下管理的所有组合,连续四个季度期间内,不同时间窗下(日内、3日内、5日内)的同向交易样本,对两两组合之间的同向交易价差均值进行原假设为0,95%的置信水平下的t检验,并对结论进行跟踪分析,分析结果显示在样本数量大于30的前提下,组合之间在同向交易方面不存在违反公平交易行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内无下列情况:所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年宏观经济明显下行,从2018年6.7%下滑至6.1%,主要是受贸易摩擦升级等影响。分季度来看,1-4季度GDP增速分别为6.4%,6.2%,6.0%和6.0%,其中出口下滑幅度最大,从2018年的9.9%下滑至2019年的0.5%;由于汽车低迷,消费也出现一定回落,社融零售品总额增速下滑1个百分点至8%,固定资产投资增速也小幅下滑,从5.9%下滑至5.4%。通胀方面,CPI上升,PPI下行,主要是猪肉的结构性通胀压力。政策方面,全年政策宽松,一季度和三季度都出现了明显的稳增长,全年减税降费超2万亿,3次降准,1次降息,社融增速上升0.4个百分点至10.7%。

A股从最低2400点在一季度单边上涨到3288,二季度震荡下跌、三季度横盘整理,四季度震荡上扬。全年从板块上看,食品饮料、电子、家电、农林牧渔、计算机涨幅排在最前。一季度市场的单边上涨主要是基于当时货币宽松,政策加码,经济强势好转的背景下助推股市全面大涨;二季度市场震荡下跌主要原因是货币略微收紧,贸易战加码,经济依然不错,但预期向下的背景下股市先快速下跌后反弹,但白酒、创新药(核心资产)是横盘整理,之后进入了上涨通道;三季度横盘整理的背景是货币保持收紧,地产限价政策加码,贸易战加码,经济出现下行趋势,但后期政策利好频出,经济预期平稳,在该背景下股市下跌后涨,科技大幅领涨,消费跟涨估值抬升,地产等周期是跌的;四季度开始震荡上扬主要是经济预期政策措施难以逆转经济下行,悲观

过度，中美关系跌宕起伏，股市下跌探底，在各种利空出尽后，股市震荡上扬。

本产品上半年以地产+新能源为主要持仓结构，考虑到中美贸易摩擦升级的背景下，国内科技行业迎来自主创新的良机，三季度策略发生了调整，逐步把地产换成半导体和消费电子，事后证明当时的决策是正确及时的，四季度新能源板块、半导体和消费电子板块成为市场上最强的龙头板块。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.3243 元；本报告期基金份额净值增长率为 47.74%，业绩比较基准收益率为 19.73%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年，预计经济增速相比 2019 年继续回落，由于疫情冲击，经济节奏预计是 V 型走势，一季度较低，二季度开始逐步回升，全年增速 5.5%~5.7%左右。从三驾马车来看，预计出口增速会小幅恢复，消费增速由于疫情影响继续回落，固定资产投资将出现一定回升，其中基建将发挥重要作用，关注新基建。通胀方面，预计 CPI 将从高点逐步下行，PPI 整体平稳。政策方面，预计财政政策更加积极和货币政策稳健阶段性宽松，专项债额度会明显增加。

长期来看，经济在疫情的负面冲击下，预计政府逆周期调控力度将进一步加大，国家会出台政策刺激汽车消费，需求短期被压制后有望出现爆发式回归，特别是新能源汽车在刺激政策和全球主要汽车厂商发力新能源汽车的双重作用下，有望提前出现拐点，迎来黄金十年。另外持续看好高端制造、5G、半导体等成长方向龙头。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会,定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由督察长、基金运营部负责人、合规稽核部负责人、权益投资部负责人、固定收益部负责人等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不介入基金日常估值业务。

##### 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据基金合同规定：“本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%”，2019 年未进行利润分配。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期内未发生连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或基金资产净值低于 5000 万的情况。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—万家基金管理有限公司 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，万家基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，万家基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

本基金 2019 年年度财务会计报告已经立信会计师事务所（特殊普通合伙）审计,注册会计师签字出具了信会师报字[2020]第 ZA30102 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	104,531,452.40	436,488,139.65
结算备付金	11,190,494.29	3,394,191.55
存出保证金	632,901.90	1,438,769.52
交易性金融资产	1,262,174,073.25	3,588,246,970.62
其中：股票投资	1,262,174,073.25	3,588,246,970.62
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	4,350,779.62	-
应收利息	44,534.54	106,349.93
应收股利	-	-
应收申购款	1,175,802.35	499,057.22
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,384,100,038.35	4,030,173,478.49
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	84,873,845.99
应付赎回款	8,033,176.60	56,852,693.88
应付管理人报酬	2,388,293.59	5,412,931.53
应付托管费	398,048.95	902,155.26
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,584,966.32	1,642,314.80
应交税费	-	-
应付利息	-	-



应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	291,652.09	366,778.95
负债合计	12,696,137.55	150,050,720.41
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,035,560,427.21	4,328,614,439.99
未分配利润	335,843,473.59	-448,491,681.91
所有者权益合计	1,371,403,900.80	3,880,122,758.08
负债和所有者权益总计	1,384,100,038.35	4,030,173,478.49

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3243 元，基金份额总额 1,035,560,427.21 份。

## 7.2 利润表

会计主体：万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	1,191,040,704.88	-932,435,665.35
1. 利息收入	4,088,412.73	5,891,085.62
其中：存款利息收入	2,421,315.48	5,431,697.26
债券利息收入	1,667,097.25	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	459,388.36
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-131,497,971.07	91,264,173.51
其中：股票投资收益	-183,923,779.48	54,089,160.43
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-391,064.04	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	15,714,377.48	448,893.20
股利收益	37,102,494.97	36,726,119.88
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,311,351,283.88	-1,034,738,339.73
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7,098,979.34	5,147,415.25
<b>减：二、费用</b>	66,971,512.07	80,211,891.54
1. 管理人报酬	45,676,534.29	56,602,837.52
2. 托管费	7,612,755.81	9,433,806.22
3. 销售服务费	-	-

4. 交易费用	13,397,447.59	13,759,310.24
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	54,470.00	1,616.02
7. 其他费用	230,304.38	414,321.54
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>1,124,069,192.81</b>	<b>-1,012,647,556.89</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>1,124,069,192.81</b>	<b>-1,012,647,556.89</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,328,614,439.99	-448,491,681.91	3,880,122,758.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,124,069,192.81	1,124,069,192.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-3,293,054,012.78	-339,734,037.31	-3,632,788,050.09
其中：1. 基金申购款	1,880,198,754.73	195,182,918.44	2,075,381,673.17
2. 基金赎回款	-5,173,252,767.51	-534,916,955.75	-5,708,169,723.26
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,035,560,427.21	335,843,473.59	1,371,403,900.80
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	2,124,146,549.62	544,532,088.79	2,668,678,638.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,012,647,556.89	-1,012,647,556.89
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	2,204,467,890.37	458,999,846.05	2,663,467,736.42
其中：1. 基金申购款	3,734,546,678.25	711,003,339.43	4,445,550,017.68
2. 基金赎回款	-1,530,078,787.88	-252,003,493.38	-1,782,082,281.26
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-439,376,059.86	-439,376,059.86
五、期末所有者权益（基金净值）	4,328,614,439.99	-448,491,681.91	3,880,122,758.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.2 财务报表由下列负责人签署：

<u>方一天</u>	<u>经晓云</u>	<u>陈广益</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金（原“万家品质生活股票型证券投资基金”）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会证监许可[2014]474号文《关于核准万家品质生活股票型证券投资基金募集的批复》的批准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于2015年7月13日至2015年7月31日止向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具安永华明(2015)验字第60778298\_B24号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2015年8月6日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币339,018,446.05元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币82,154.91元，以上实收基金（本息）合计为人民币339,100,600.96元，折合339,100,600.96份基金份额。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金已于2016年3月8日召开基金份额持有人大会，对本基金名称、基金投资范围等事项进行相应修改。根据基金份额持有人大会决议，原“万家品质生活股票型证券投资基金”更名为“万

家品质生活灵活配置混合型证券投资基金”。基金管理人已将修改后的《万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金托管协议》和《万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》报中国证监会进行变更注册，修订和更新后的文件于 2016 年 3 月 8 日生效。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等）、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款及协议存款）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。通过投资于中国经济社会发展过程中所涌现出的能够直接或间接满足居民生活品质提升需求的上市公司，在严格控制投资风险的基础上，谋求基金资产的长期稳定增值。本基金业绩比较基准为：50%\*沪深 300 指数收益率+50%\*上证国债指数收益率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### (一) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### (二) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，管理人接受投资者委托或信托对受托资产提供的管理服务以及管理人发生的其他增值税应税行为，按照现行规定缴纳增值税，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。本通知自 2018 年 1 月 1 日起施行，对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

### (三) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### (四) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别

化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
新疆国际实业股份有限公司	基金管理人的股东
齐河众鑫投资有限公司	基金管理人的股东
山东省国有资产投资控股有限公司	基金管理人的原股东
万家共赢资产管理有限公司	基金管理人的子公司
万家财富基金销售（天津）有限公司	基金管理人的子公司、基金销售机构
上海万家朴智投资管理有限公司	基金管理人控制的公司

注：1、经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]126 号文核准，基金管理人原股东山东省国有资产投资控股有限公司将其持有的基金管理人的 11%股权转让给齐河众鑫投资有限公司。本次股权变更的工商变更登记手续已办理完毕，基金管理人于报告期内 2019 年 2 月 13 日发布了《关于公司股权变更的公告》，公司股东由山东省国有资产投资控股有限公司变更为齐河众鑫投资有限公司。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
中泰证券	706,695,913.99	9.31%	1,082,333,867.93	11.06%

##### 7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

### 7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

### 7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中泰证券	658,147.96	9.31%	463,981.31	29.29%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中泰证券	1,007,975.64	11.06%	589,987.51	35.92%

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	45,676,534.29
其中：支付销售机构的客户维护费	2,110,587.24	1,470,985.99

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。



### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,612,755.81	9,433,806.22

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。

### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	104,531,452.40	1,987,202.77	436,488,139.65	5,018,811.76

注：本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限公司，2019 年度获得的利息收入为人民币 28,509.25 元(2018 年度：人民币 99,938.79 元)，2019 年末结算备付

金余额为人民币 1,074,421.58 元(2018 年末:人民币 3,394,191.55 元)。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本年度及上年度末均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

#### 7.4.9 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002973	侨银环保	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 6 日	新股发行	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
688007	光峰科技	2019 年 7 月 12 日	2020 年 1 月 22 日	新股锁定	17.50	26.91	26,857	469,997.5	722,721.87	-
688015	交控科技	2019 年 7 月 16 日	2020 年 1 月 22 日	新股锁定	16.18	32.32	12,549	203,042.82	405,583.68	-
688021	奥福环保	2019 年 10 月 29 日	2020 年 5 月 6 日	新股锁定	26.17	33.32	2,940	76,939.80	97,960.80	-
688037	芯源微	2019 年 12 月 6 日	2020 年 6 月 16 日	新股锁定	26.97	58.98	3,028	81,665.16	178,591.44	-
688268	华特气体	2019 年 12 月 19 日	2020 年 6 月 29 日	新股锁定	22.16	35.78	5,216	115,586.56	186,628.48	-

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603799	华友钴业	2019 年 12 月 31 日	重大事项	39.39	2020 年 1 月 2 日	40.43	3,380,991	152,043,872.84	133,177,235.49	-

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (一) 公允价值

##### 1、金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 2、持续的以公允价值计量的金融工具

###### (1) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日,本基金持有的交易性金融资产中属于第一层次的余额为 1,127,398,773.45 元,属于第二层次的余额为 134,775,299.80 元,无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日:属于第一层次的余额为 3,584,406,441.31 元,属于第二层次的余额为 3,840,529.31 元,无属于第三层次的余额)。

###### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

###### (3) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具本期末和上年度末均未以第三层次公允价值计量。

3、非持续的以公允价值计量的金融工具

本基金本期及上年度可比期间未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

4、不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(二)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,262,174,073.25	91.19
	其中：股票	1,262,174,073.25	91.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	115,721,946.69	8.36
8	其他各项资产	6,204,018.41	0.45
9	合计	1,384,100,038.35	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	51,594,337.76	3.76
B	采矿业	-	-
C	制造业	933,346,485.53	68.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,004.16	0.00
E	建筑业	91,897.51	0.01
F	批发和零售业	67,361,080.14	4.91
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,549,068.92	3.61
J	金融业	92,628,392.81	6.75
K	房地产业	67,467,235.96	4.92
L	租赁和商务服务业	46,980.22	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	50,012.20	0.00
	合计	1,262,174,073.25	92.04

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资组合。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300618	寒锐钴业	1,620,362	133,501,625.18	9.73
2	603799	华友钴业	3,380,991	133,177,235.49	9.71
3	002460	赣锋锂业	3,620,335	126,096,268.05	9.19
4	603986	兆易创新	597,025	122,324,452.25	8.92
5	002371	北方华创	1,377,147	121,188,936.00	8.84
6	002241	歌尔股份	5,254,123	104,662,130.16	7.63
7	300136	信维通信	1,983,990	90,033,466.20	6.57
8	002384	东山精密	3,752,450	86,869,217.50	6.33
9	002299	圣农发展	2,142,622	51,594,337.76	3.76
10	300369	绿盟科技	2,731,584	49,496,302.08	3.61

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603986	兆易创新	211,625,067.01	5.45
2	300059	东方财富	190,606,200.30	4.91
3	603019	中科曙光	167,269,167.86	4.31
4	300369	绿盟科技	142,291,154.86	3.67
5	002405	四维图新	136,231,066.79	3.51

6	002373	千方科技	133,829,693.98	3.45
7	002371	北方华创	125,088,187.71	3.22
8	002384	东山精密	121,026,176.49	3.12
9	300136	信维通信	106,850,562.39	2.75
10	600030	中信证券	104,074,042.92	2.68
11	002273	水晶光电	93,988,569.42	2.42
12	600570	恒生电子	88,063,954.28	2.27
13	002230	科大讯飞	85,127,554.49	2.19
14	002241	歌尔股份	81,517,306.17	2.10
15	000063	中兴通讯	66,420,018.24	1.71
16	300618	寒锐钴业	58,124,627.06	1.50
17	002594	比亚迪	57,359,485.87	1.48
18	300433	蓝思科技	49,399,779.60	1.27
19	000066	中国长城	21,572,433.00	0.56
20	300450	先导智能	13,747,827.00	0.35

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603986	兆易创新	293,302,694.47	7.56
2	600760	中航沈飞	275,392,775.94	7.10
3	000066	中国长城	271,790,119.49	7.00
4	600048	保利地产	258,154,377.44	6.65
5	002466	天齐锂业	248,113,770.91	6.39
6	300073	当升科技	227,040,136.01	5.85
7	002460	赣锋锂业	226,420,682.71	5.84
8	001979	招商蛇口	214,219,641.21	5.52
9	601155	新城控股	211,431,807.12	5.45
10	002146	荣盛发展	210,308,424.93	5.42
11	600383	金地集团	192,949,307.93	4.97
12	600606	绿地控股	179,121,978.46	4.62
13	002024	苏宁易购	160,239,820.75	4.13
14	603799	华友钴业	154,965,595.49	3.99
15	300059	东方财富	145,625,430.70	3.75
16	002013	中航机电	128,360,150.35	3.31
17	002373	千方科技	127,963,885.63	3.30

18	300369	绿盟科技	127, 123, 416. 84	3. 28
19	600967	内蒙一机	124, 940, 087. 11	3. 22
20	002405	四维图新	124, 503, 122. 75	3. 21
21	603019	中科曙光	124, 372, 957. 95	3. 21
22	600884	杉杉股份	119, 412, 494. 98	3. 08
23	002273	水晶光电	109, 925, 276. 31	2. 83
24	002025	航天电器	101, 307, 871. 01	2. 61
25	600570	恒生电子	96, 898, 308. 35	2. 50
26	600338	西藏珠峰	93, 123, 926. 36	2. 40
27	002230	科大讯飞	88, 334, 471. 43	2. 28
28	002594	比亚迪	86, 967, 292. 51	2. 24
29	603883	老百姓	81, 677, 425. 66	2. 11
30	600885	宏发股份	80, 738, 889. 31	2. 08

注：本项卖出金额均按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2, 080, 147, 915. 36
卖出股票收入（成交）总额	5, 533, 648, 317. 13

注：本项买入金额均按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用

本项卖出金额均按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。



### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据有关法律规和政策的定，在严格控制风险前提下，本着谨慎原则，以套期保值为主要目的，参与股指期货投资。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情判断和组合风险收益分析的基础上。本金将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。本基金将股票资的总体规模、以及法律或中国证监会相关定，确定参与股指期货交易的投资比例。

本基金将充分考虑股指期货的收益性、流动及风险特征，运用股指期货对冲系统性风险以及大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险，以达到降低投资组合整体风险的目的。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期期末未持有国债期货合约。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

#### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	632,901.90
2	应收证券清算款	4,350,779.62
3	应收股利	-
4	应收利息	44,534.54
5	应收申购款	1,175,802.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,204,018.41

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	603799	华友钴业	133,177,235.49	9.71	重大事项

**8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
57,964	17,865.58	834,218,495.49	80.56%	201,341,931.72	19.44%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	31,839.97	0.0031%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部 门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年8月6日）基金份额总额	339,100,600.96
本报告期期初基金份额总额	4,328,614,439.99
本报告期基金总申购份额	1,880,198,754.73
减:本报告期基金总赎回份额	5,173,252,767.51
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,035,560,427.21

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

公司高级管理人员：

首席信息官：

2019 年 6 月 13 日，公司聘任陈广益先生担任公司首席信息官。

副总经理：

2019 年 7 月 20 日，公司聘任满黎先生担任公司副总经理。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期期内基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期期为基金进行审计的会计师事务所未发生变更。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比	佣金	占当期佣金 总量的比例	

			例			
华福证券	2	1,381,466,790.47	18.21%	1,286,562.91	18.21%	-
恒泰证券	1	899,658,819.76	11.86%	837,852.94	11.86%	-
银河证券	2	881,876,145.80	11.62%	821,290.87	11.62%	-
广发证券	1	771,848,678.19	10.17%	718,823.57	10.17%	-
中泰证券	2	706,695,913.99	9.31%	658,147.96	9.31%	-
安信证券	1	620,232,025.17	8.18%	577,622.99	8.18%	-
中信建投	2	568,017,368.68	7.49%	528,995.62	7.49%	-
国盛证券	1	552,974,300.23	7.29%	514,982.31	7.29%	-
新时代证券	1	372,280,010.24	4.91%	346,705.42	4.91%	-
天风证券	1	319,362,162.79	4.21%	297,422.89	4.21%	-
华泰证券	2	277,926,599.69	3.66%	258,833.59	3.66%	-
海通证券	1	234,575,145.72	3.09%	218,458.54	3.09%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、报告期内基金租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内，本基金新增安信证券交易单元 1 个，中信建投证券交易单元 2 个。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华福证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190101 - 20190306, 20190315 - 20191212	903,508,485.87	0.00	903,508,485.87	0.00	0.00%
	2	20190305 - 20190305, 20190307 - 20190409, 20190719 - 20191231	740,662,663.26	588,260,218.72	1,041,085,456.27	287,837,425.71	27.80%
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

万家基金管理有限公司

2020 年 3 月 25 日